

**<<資金需給>>**

単位 億円

	2日需給速報		3日需給予想	4日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,000	▲ 2,000	▲ 2,000
財政		▲ 74,400	4,800	7,000
資金過不足		▲ 75,400	2,800	5,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
64,615				
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証券買入				
国庫短期証券売却				
国債買入		11,100		4,700
CP等買入		▲ 200	▲ 100	
貸出支援基金(成長)				11,000
51,505(増加) 252,028				▲ 4,000
被災地支援				
3,161				
社債等買入				
ETF買入				
国債補完供給	即日	▲ 100	100	
小計		10,800	0	11,700
当増減		▲ 64,600	2,800	16,700

当座預金残高	2,379,500	12/2以降の残り所要積立額	5,600
準備預金残高	2,169,500	12/3以降の残り所要積立額	4,500
積み終了先	1,770,800	積数	300
超過準備	1,770,800	1日平均	300
非準預先残高	210,000	積み期間(11/16~12/15)の所要準備額(積数)	1,961,300
準備預金進捗率	99.77% (実績)		56.67% (日数)

12/1のマナタリーベース		3,422,900	
12/1コール	合計	198,954 無担	60,055 有担
コール前日増減	計	3,635 無担	1,558 有担
			2,077

12/2の加重平均レート(速報)				12/1の加重平均レート(確報)				単位(%)
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		無担先日付分		有担当日分
0.060 ~0.125 (0.077)	0.030 ~0.040 (0.031)	O/N	0.060 ~0.080 (0.076)			0.030 ~0.040 (0.031)		
0.073 ~0.121 (0.078)		T/N				0.073 ~0.121 (0.079)		
		S/N						
0.117 ~0.130 (0.124)		1W				0.155 (0.155)		
0.310 (0.310)		2W				0.160 ~0.165 (0.161)		
		3W						
		1M						有担先日付分
		2M				0.120 (0.120)		
		3M	▲0.07-▲0.0575					
		6M	-					
		1Y	-					

**<<オペ情報、入札結果>>**

国債補完	5,248億円	12/2	~ 12/3 (1日間)	応札	55億円	落札	55億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
国債買入	700億円	12/4	応札	3,180億円	落札	700億円		0.022%	63.3%	平均	0.025%
国債買入	4,000億円	12/4	応札	10,909億円	落札	4,014億円		-0.003%	93.4%	平均	-0.003%

「このレポートは、参考資料としてのみ作成しております。売買に関する最終判断はお客様ご自身でなされますようお願い申し上げます。」

金融商品のお取引には価格変動等によるリスクがあります。金融商品のお取引には手数料等をご負担頂くものがあります。金融商品取引法に基づきお渡しする書面や目論見書をよくお読みください。セントラル短資株式会社 登録金融機関 関東財務局長(登金)第526号 日本証券業協会加入

<< 12/3の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,382,300	前日比	2,800
O/N	0.07~0.08	T/N	0.07~0.12	S/N	0.07~0.12

無担O/Nは0.075%前後での出合いが中心になると見込まれる。

<< 2日のインターバンク市場動向 >>  
午前8時発表の準備預金残高見込みは、前日比6兆4000億円減の177兆6,000億円(当座預金残高見込みは、238兆2,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀、信託、証券業態の0.075~0.077%、大手行からは0.075%の調達希望。法人税・年金保険料揚げの影響で、資金需給上は大幅な不足日であったものの、出合いの中心は0.076~0.077%と昨日と同水準の立ち上がりとなった。また、一部業態が試し取りと見られる調達を行った。一巡後は0.07~0.075%での出合いが散見されつつ、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、本日もロール案件での出合いが散見される程度であった。

<< 2日のオープン市場動向 >>  
現先S/N物は低位横ばい圏で推移。短国市場は動意に乏しく閑散。3M物で▲0.07~▲0.0575%の出合いが見られた程度となった。CP市場は鉄鋼業態からまとまった発行案件が見られ、発行総額は1,600億円程度まで膨らんだ。発行レートは引続き低位横ばい圏での取引となった。

- << 3日の材料 >>
- \*木内日銀審議委員、資本市場研究会にて講演
  - \*12月の日銀当座預金増減要因見込み
  - \*米国10月の製造業新規受注・出荷・在庫
  - \*米国11月のISM非製造業景況指数
  - \*ECB定例理事会(金融政策発表)
  - \*国庫短期証券入札(3ヶ月、48,000億円、12/7発行)
  - \*流動性供給入札(3,000億円、12/7発行)
  - \*交付税特別会計借入(10,500億円、12/11借入)

<<コール11月の加重平均レート>>			
(土日を含む)	無担	0.07763%	有担 0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.07811%	有担 0.03100%

JGB新発10年債	0.320	0.000	日経平均株価(終値)	19,938.13	▲ 74.27	為替(9時)	122.90-92
						為替(5時)	123.05-07

O/N加重平均レートと日銀当座預金残高及び準備預金残高の推移						
日付	11/25	11/26	11/27	11/30	12/1	12/2
日銀当預残	2,449,300	2,458,300	2,439,900	2,458,600	2,444,100	2,379,500
準備預金残	2,231,600	2,241,800	2,222,300	2,249,100	2,233,300	2,169,500
レート	0.078%	0.076%	0.077%	0.076%	0.076%	0.077%
月中平均	0.07784%	0.07777%	0.07769%	0.07763%	0.07600%	0.07650%